

交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)

[2014]半年度报告摘要

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年八月二十五日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本基金的半年度报告经三分之二以上独立董事签字同意。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要需遵守半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期中财务报告未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)
场内简称	交银施利
基金代码	164902(场内)
交易代码	164903(场外)
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同成立日	2011年1月25日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金总资产	245,260,248.45
报告期末基金份额总额	245,260,248.45
报告期末每份净值	-
基金类别	债券型
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所
报告期末基金份额总额	245,260,248.45
报告期末每份净值	-
报告期末基金份额总额	245,260,248.45
报告期末每份净值	-

注:根据《基金合同》及《招募说明书》的相关规定,本基金在基金合同生效之日起三年(含三年)的期间内,将定期对开放操作,在深圳证券交易所上市,封闭期结束后转为上市开放式基金(LOF)。本基金的封闭期自2011年1月25日至基金合同生效之日起至2014年1月25日止,自2014年1月25日起进入其后的运作方式为“上市契约型开放式”,并于其日起成为本基金的份额,赎回业务,本基金在募集期仅开放前端基金份额的认购,转为上市开放式基金(LOF)后将同时开通前端基金份额和后端基金份额的申购赎回。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金根据宏观经济运行状况和金融市场的情况,自上而下地进行宏观策略分析,以下向上精炼个层次,在控制信用风险、利率风险和流动性风险的前提下,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金主要通过分析和预测宏观经济状况以及金融市场运行趋势,把握信用债、基础类资产配置调整的类属资产比例,并结合对信用债品种的深入研究,严控信用风险,精选具有较高流动性的信用债品种,在分析和预测宏观经济状况以及金融市场运行趋势的基础上,通过久期策略、信用策略、期限策略等,自下而上地构建组合,力争在保证本金安全的前提下,实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	80%×中债企业债全价指数收益率+20%×中债国债全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于适合投资家庭中等风险品种,其长期平均的预期收益和风险收益特征低于货币基金,但高于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 交银施罗德基金管理有限公司 中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人 姓氏 张弛 李芳华

联系电话 021-61055000 010-66006009

电子邮箱 xsp@jdyd.com;disclosure@jydd.com ltfang@abcchina.com

客户服务电话 400-700-5000-021-61055000 010-68121816

传真 021-61055054 010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址 www.fund01.com;www.bocomchsider.com

基金半年度报告备置地点 基金管理人办公场所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 本期利润和报告期末余额

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

本期利润 -63,832,305.87

未分配利润 -3,036,195.96

加权平均基金份额本期利润 -0.0045

期末基金资产净值增长率为 3.3%

报告期(2014年6月30日)

期初可供分配基金利润 -0.003

期末可供分配基金份额余额 253,428,311.65

期末可供分配基金份额净额 1.003

注:1. 报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.033元,基金份额总额245,260,248.45份。

2. 本期主要向资产负债表和利润表列示的附注号为半年度报告正文中的对应的附注号,投资者欲了解相关附注的内容,可阅读附注于基金管理人网站的半年度报告全文。

6.2 利润表

会主任:交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目 附注号 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度同期(2013年1月1日至2013年6月30日)

一、收入 3,938,295.78 80,959,175.65

1.利息收入 19,911,075.05 71,449,966.33

其中:存款利息收入 1,902,866.66 584,729.77

2.债券利息收入 16,017,039.58 70,684,162.91

3.买入返售金融资产收入 1,991,048.81 18,638.50

4.投资收益 -77,019,305.39 17,613,567.94

其中:股息红利收益 6,471.12 -8,745,102.66 -16,278,954.08

5.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 60,796,109.91 -2,358.62

6.汇兑收益(损失以“-”号填列) - -

7.其他收入 250,161.21 -

减:利息费用 6,974,491.74 29,287,366.25

8.所得税费用 2,022,649.19 6,034,812.83

9.投资损失 674,218.11 2,011,604.26

10.公允价值变动损失(收益以“-”号填列) - -

11.其他支出 6,471.17 213,030.00

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) - -

4.汇兑损失(收益以“-”号填列) - -

5.其他收入(损失以“-”号填列) 6,471.18 -2,358.62

6.2.2 资产负债表

会主任:交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目 附注号 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度同期(2013年1月1日至2013年6月30日)

一、收入 3,938,295.78 80,959,175.65

1.利息收入 19,911,075.05 71,449,966.33

其中:存款利息收入 1,902,866.66 584,729.77

2.债券利息收入 16,017,039.58 70,684,162.91

3.买入返售金融资产收入 1,991,048.81 18,638.50

4.投资收益 -77,019,305.39 17,613,567.94

其中:股息红利收益 6,471.12 -8,745,102.66 -16,278,954.08

5.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 60,796,109.91 -2,358.62

6.汇兑收益(损失以“-”号填列) - -

7.其他收入 250,161.21 -

减:利息费用 6,974,491.74 29,287,366.25

8.所得税费用 2,022,649.19 6,034,812.83

9.投资损失 674,218.11 2,011,604.26

10.公允价值变动损失(收益以“-”号填列) - -

11.其他支出 6,471.17 213,030.00

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) - -

4.汇兑损失(收益以“-”号填列) - -

5.其他收入(损失以“-”号填列) 6,471.18 -2,358.62

6.2.3 所有者权益(基尼净值)变动表

会主任:交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目 附注号 2014年1月1日至2014年6月30日 上年度同期(2013年1月1日至2013年6月30日)

一、本期利润 3,938,295.78 80,959,175.65

二、期初所有者权益(基金净值) 1,895,085,749.23 59,391,954.07

三、本期期末所有者权益(基金净值) 1,924,024,045.01 68,383,909.10

四、本期基金份额变动情况 1,448,255,250.00 1,448,255,250.00

五、本期期末基金份额总额 253,428,311.65 253,428,311.65

六、本期期末每份基金净值 1.003 1.003

七、本期期末可供分配基金份额利润 -3,036,195.96 -3,036,195.96

八、本期期末可供分配基金份额总额 250,392,115.69 250,392,115.69

九、本期期末基金资产净值 250,392,115.69 250,392,115.69

十、本期期末基金份额净值 1.003 1.003

十一、本期期末可供分配利润总额 -3,036,195.96 -3,036,195.96

十二、本期期末可供分配基金份额总额 250,392,115.69 250,392,115.69

十三、本期期末可供分配基金份额净值 1.003 1.003

十四、本期期末可供分配基金份额总额与本期期末基金资产净值的差额 -3,036,195.96 -3,036,195.96

十五、本期期末可供分配基金份额总额与本期期末基金份额净值的差额 -3,036,195.96 -3,036,195.96

十六、本期期末可供分配基金份额总额与本期期末基金资产净值的差额 -3,036,195.96 -3,036,195.96

十七、本期期末可供分配基金份额总额与本期期末基金份额净值的差额 -3,036,195.96 -3,036,195.96

十八、本期期末可供分配基金份额总额与本期期末基金资产净值的差额 -3,036,195.96 -3,036,